

ABSTRAK

Penelitian ini dilakukan untuk menguji pengaruh variabel *Economic Value Added* (EVA), *Return On Asset* (ROA), *Earning Per Share* (EPS), *Price Earning Ratio* (PER), *Debt to Equity Ratio* (DER), *Loan to Deposit Ratio* (LDR), dan Persentase Kepemilikan Modal Saham Asing (PKMSA) terhadap harga saham perusahaan perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia.

Data sekunder yang digunakan dalam penelitian ini diperoleh dari Bursa Efek Indonesia diperoleh dari situs <http://www.idx.co.id/> dan di Perpustakaan UPN “Veteran” Yogyakarta diperoleh dari *Indonesian Capital Market Directory* (ICMD). Data yang diambil laporan keuangan, laporan kepemilikan saham, dan harga saham penutupan (*closing price*) perusahaan perbankan selama tahun 2008 sampai 2010. Populasi dalam penelitian ini adalah perusahaan perbankan yang terdaftar sebagai emiten di Bursa Efek Indonesia selama tahun 2008 sampai 2010. Sampel ditentukan dengan teknik *purposive sampling* dengan tujuan untuk mendapatkan sampel yang representatif sesuai dengan kriteria yang ditentukan. Adapun sampel dalam penelitian ini ada 18 perusahaan perbankan. Penelitian ini dianalisis dengan menggunakan regresi linier berganda.

Hasil uji statistik menunjukkan bahwa variabel *Economic Value Added* (EVA), *Return On Asset* (ROA), *Earning Per Share* (EPS), *Price Earning Ratio* (PER), *Debt to Equity Ratio* (DER), *Loan to Deposit Ratio* (LDR), dan Persentase Kepemilikan Modal Saham Asing (PKMSA) secara simultan berpengaruh signifikan terhadap harga saham perusahaan perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia. Sedangkan hanya variabel *Economic Value Added* (EVA), *Return On Asset* (ROA), *Earning Per Share* (EPS), *Price Earning Ratio* (PER), dan *Debt to Equity Ratio* (DER) yang secara parsial berpengaruh signifikan terhadap harga saham perusahaan perbankan yang terdaftar di Bursa Efek Indonesia.

Kata kunci : *Economic Value Added* (EVA), *Return On Asset* (ROA), *Earning Per Share* (EPS), *Price Earning Ratio* (PER), *Debt to Equity Ratio* (DER), *Loan to Deposit Ratio* (LDR), Persentase Kepemilikan Modal Saham Asing (PKMSA), dan Harga Saham